# 万家元启价值量化选股混合型发起式证券投资基金基金产品资料概要

编制日期：2026 年 11 月 16 日

送出日期：2026 年 11 月 17 日

**本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。**

**作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。**

## 一、产品概况

| | | | |
|---|---|---|---|
| 基金简称 | 万家元启价值量化选股混合发起式 | 基金代码 | 029881 |
| 下属基金简称 | 万家元启价值量化选股混合发起式 A | 下属基金代码 | 029881 |
| 下属基金简称 | 万家元启价值量化选股混合发起式 C | 下属基金代码 | 029882 |
| 基金管理人 | 万家基金管理有限公司 | 基金托管人 | 上海银行股份有限公司 |
| 基金合同生效日 | | | |
| 基金类型 | 混合型 | 交易币种 | 人民币 |
| 运作方式 | 普通开放式 | 开放频率 | 每日 |
| 基金经理 | 李自龙 | 开始担任本基金基金经理的日期 | |
| | | 证券从业日期 | 2017-02-27 |
| 终止条款 | 《基金合同》生效之日起 3 年后的年度对应日，若基金资产净值低于 2 亿元的，《基金合同》自动终止，不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。若届时的法律法规或中国证监会规定发生变化，上述终止规定被取消、更改或补充，则本基金可以参照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。<br>法律法规、中国证监会或基金合同另有规定时，从其规定。 | | |

## 二、基金投资与净值表现

### （一） 投资目标与投资策略

请投资者阅读《招募说明书》第九部分了解详细情况

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期增值。 |
| 投资范围 | 本基金的主要投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板以及其他中国证监会允许上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、股指期货、国债期货、股票期权以及债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、证券公司短期公司债、政府 |

| | |
|---|---|
| | 支持机构债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、信用衍生品以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。<br>本基金可根据法律法规的规定参与融资业务。<br>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。<br>基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比例为60%-95%,其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的50%;每个交易日日终在扣除股票期权、股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。 |
| 主要投资策略 | 1、大类资产配置策略；2、股票投资策略：（1）量化多因子策略；（2）组合优化策略；（3）港股通标的股票投资策略；（4）存托凭证投资策略；3、债券投资策略；4、资产支持证券投资策略；5、可转换债券与可交换债券投资策略；6、证券公司短期公司债券投资策略；7、股指期货交易策略；8、国债期货交易策略；9、股票期权投资策略；10、信用衍生品投资策略；11、融资交易策略。 |
| 业绩比较基准 | 中证800价值指数收益率*75%+恒生指数收益率*5%+中债-新综合全价（1-3年）指数收益率*15%+活期存款基准利率*5% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，其预期风险收益水平理论上低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。<br>本基金可投资于港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险、汇率风险、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险等。 |

## 三、投资本基金涉及的费用

### （一） 基金销售相关费用

以下费用在申购/赎回基金过程中收取：

万家元启价值量化选股混合发起式A

| 费用类型 | 份额（S）或金额（M）/持有期限（N） | 收费方式/费率 | 备注 |
|---|---|---|---|
| 认购费 | M< 100万元 | 0.80% | - |
| | 100万元≤M< 300万元 | 0.60% | - |
| | 300万元≤M< 500万元 | 0.40% | - |
| | 500万元≤M | 1000元/笔 | - |
| 申购费（前收费） | M< 100万元 | 0.80% | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 100 万元≤M< 300 万元 | 0.60% | - |
| | 300 万元≤M< 500 万元 | 0.40% | - |
| | 500 万元≤M | 1000 元/笔 | - |
| 赎回费 | N< 7 天 | 1.50% | - |
| | 7 天≤ N< 30 天 | 1.00% | - |
| | 30 天≤ N< 180 天 | 0.50% | - |
| | 180 天≤ N | 0.0 | - |

万家元启价值量化选股混合发起式 C

| 费用类型 | 份额（S）或金额（M）/持有期限（N） | 收费方式/费率 | 备注 |
|---|---|---|---|
| 赎回费 | N< 7 天 | 1.50% | - |
| | 7 天≤ N< 30 天 | 1.00% | - |
| | 30 天≤ N< 180 天 | 0.50% | - |
| | 180 天≤ N | 0.0 | - |

1、本基金 C 类基金份额不收取认购费/申购费。

2、投资者通过直销机构及其销售子公司以外的其他销售机构认购/申购本基金 A 类基金份额时收取认购费/申购费，通过直销机构及其销售子公司认购/申购本基金 A 类基金份额时不收取认购费/申购费。

## （二） 基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除：

| 费用类别 | 收费方式/年费率或金额 | 收取方 |
|---|---|---|
| 管理费 | 本基金根据每一基金份额的持有期限与持有期间年化收益率，在赎回、转换转出基金份额或基金合同终止清算时确定该笔基金份额对应的管理费。当投资者赎回、转换转出基金份额或基金合同终止清算时，持有期限不足一年（即 365 天，下同），则按 1.20%年费率收取管理费；持有期限达到一年及以上，则根据持有期间年化收益率分为以下三种情况，分别确定对应的管理费率档位：<br>若持有期间相对业绩比较基准的年化超额收益率（扣除超额管理费后）超过 6%且持有收益率（扣除超额管理费后）为正，按 1.50%年费率 | 基金管理人和销售机构 |

| | | |
|---|---|---|
| | 确认管理费；若持有期间相对业绩比较基准的年化超额收益率在-3%及以下，按0.60%年费率确认管理费；其他情形按1.20%年费率确认管理费。 | |
| 托管费 | 0.20% | 基金托管人 |
| 万家元启价值量化选股混合发起式C销售服务费 | 0.40% | 销售机构 |
| 其他费用 | 按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。 | - |

注：1、本基金的管理费由固定管理费、或有管理费和超额管理费组成，其中或有管理费和超额管理费取决于每笔基金份额的持有时长和持有期间年化收益率水平,详见基金合同“第十五部分 基金费用与税收”。

2、本基金A类基金份额不收取销售服务费。

3、本基金交易证券、基金等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。

4、上表中的销售服务费适用于投资者通过直销机构及其销售子公司以外的其他销售机构认购/申购且持续持有期限未超过一年的C类基金份额。对于投资者通过直销机构及其销售子公司认购/申购的C类基金份额，计提的销售服务费将在投资者赎回相应基金份额或基金合同终止时随赎回款或清算款一并返还给投资者;对于投资者通过其他销售机构认购/申购的C类基金份额，持续持有期限超过一年继续计提的销售服务费将在投资者赎回相应基金份额或基金合同终止时随赎回款或清算款一并返还给投资者。

## 四、风险揭示与重要提示

### （一） 风险揭示

**本基金不提供任何保证。投资者可能损失本金。**

**投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。**

**本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资有风险，投资者在投资本基金前，应当认真阅读基金招募说明书、基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，自主判断基金的投资价值，对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，承担基金投资中出现的各类风险。投资本基金可能遇到的风险包括：市场风险、管理风险、流动性风险、本基金的特有风险和其他风险等；本基金的投资范围包括股指期货、股票期权、国债期货、资产支持证券、证券公司短期公司债、信用衍生品等品种，本基金可根据法律法规的规定参与融资业务，可能给本基金带来额外风险。**

**本基金参与港股通交易，基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资于港股。**

**本基金投资内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票的，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行T+0回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比A股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来**

的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。

《基金合同》生效之日起 3 年后的年度对应日，若基金资产净值低于 2 亿元的，《基金合同》自动终止，不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。本基金将根据基金合同的约定进行基金财产清算并终止，投资人将面临基金终止清盘的风险。

本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于境内市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临投资存托凭证的特殊风险。

为对冲信用风险，本基金可能投资信用衍生品，信用衍生品的投资可能面临流动性风险、偿付风险以及价格波动风险。

当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，基金管理人履行相应程序后，可以启动侧袋机制，具体详见基金合同和招募说明书的有关章节。侧袋机制实施期间，基金管理人将对基金简称进行特殊标识，并不办理侧袋账户的申购赎回。请基金份额持有人仔细阅读相关内容并关注本基金启用侧袋机制时的特定风险。

本基金为混合型基金，其预期风险收益水平理论上低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

本基金采用量化模型构建投资组合，量化模型仅是选股模型，并不基于量化模型进行高频交易。在实际运作过程中，本基金通过量化模型选择股票并构建股票投资组合，存在失效并导致基金亏损的风险，同时宏观经济环境、股票市场环境、交易规则等发生重大变化也可能会影响模型的有效性，无法达到预期的投资效果。

浮动管理费模式相关风险：（1）本基金的管理费由固定管理费、或有管理费和超额管理费组成，其中或有管理费和超额管理费取决于每笔基金份额的持有时长和持有期间年化收益率水平（详见基金合同“第十五部分 基金费用与税收”），因此投资者在认/申购本基金时无法预先确定本基金的整体管理费水平。（2）根据基金合同约定，对于投资者赎回、转换转出基金份额或基金合同终止的情形发生时持有期限不足一年的基金份额，将不考虑其收益率情况，均按 1.20%的年费率收取管理费，因此存在投资者的持有期间年化收益率低于业绩比较基准一定比例，但因持有期限不满一年从而无法获得或有管理费返还的风险。（3）本基金在计算基金份额净值时，按前一日基金资产净值的 1.20%年费率计算管理费，该费率可能高于或低于不同投资者最终适用的管理费率。在基金份额赎回、转换转出或基金合同终止情形下，投资者持有期间实际年化收益率可能与按披露的基金份额净值计算的年化收益率存在差异，投资者的实际赎回款项、转换转出款项或清算款项的金额可能与按披露的基金份额净值计算的结果存在差异，具体以登记机构确认数据为准。（4）本基金采用浮动管理费的收费模式，不代表基金管理人对基金投资收益的保证。

本基金的具体风险详见招募说明书的“风险揭示”部分。

## （二） 重要提示

中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

基金产品资料概要信息发生重大变更的，基金管理人将在三个工作日内更新，其他信息发生变更的，基金管理人每年更新一次。因此，本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确获取基金的相关信息，敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

**各方当事人同意，因《基金合同》的订立、内容、履行和解释或与《基金合同》有关的一切争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决，如经友好协商、调解未能解决的，任何一方均有权将争议提交上海国际经济贸易仲裁委员会，按照其届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为上海市。仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力。除非仲裁裁决另有决定，仲裁费用、律师费用由败诉方承担。**

## 五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站[网址：www.wjasset.com][客服电话:400-888-0800]

基金合同、托管协议、招募说明书

定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告

基金份额净值

基金销售机构及联系方式

其他重要资料

## 六、其他情况说明

暂无。